富安达中证 A500 指数增强型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:富安达基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 14
§5 托管人报告 14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 14
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 14
6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 16
6.3 净资产变动表 18
6.4 报表附注 20
§7 投资组合报告 43
7.1 期末基金资产组合情况 43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 54
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 54
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 54
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 54
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 54
7.12 投资组合报告附注 54
§8 基金份额持有人信息 55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 56

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 57
§9 开放式基金份额变动 57
§10 重大事件揭示 57
10.1 基金份额持有人大会决议 58
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 58
10.4 基金投资策略的改变 58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 58
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 58
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 59
10.8 其他重大事件 60
§11 影响投资者决策的其他重要信息 61
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 62
§12 备查文件目录 62
12.1 备查文件目录 62
12.2 存放地点 62
12.3 查阅方式 62

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富安达中证A500指数增强型证券投资基金	
基金简称	富安达中证A500指数增强	
基金主代码	023435	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025年04月01日	
基金管理人	富安达基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	39,034,281.60份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	富安达中证A500指数增强A	富安达中证A500指数增强C
下属分级基金的交易代码	023435	023436
报告期末下属分级基金的份额总额	24,185,902.26份	14,848,379.34份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过量化投资的方式进行积极的投资组合管理与风险控制，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	本基金作为增强型的指数基金，以量化组合投资管理方式为基础，力求在控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%、年跟踪误差不超过8.0%的基础上获取超越标的指数的表现。 本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。
业绩比较基准	中证A500指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金是一只股票型指数增强基金，其预期风险

	与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富安达基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李理想	方圆
	联系电话	021-61870999	95559
	电子邮箱	service@fadfunds.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-630-6999	95559
传真		021-61870888	021-62701216
注册地址		上海市浦东新区世纪大道1568号29楼	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1568号29楼	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		200122	200336
法定代表人		王胜	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.fadfunds.com
基金中期报告置备地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	富安达基金管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1568号中建大厦29楼

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026年01月01日-2026年06月30日)	
	富安达中证A500指数增强A	富安达中证A500指数增强C
本期已实现收益	2,080,576.61	1,440,702.75
本期利润	2,700,844.62	1,724,723.03
加权平均基金份额本期利润	0.0998	0.1018
本期加权平均净值利润率	8.22%	8.41%
本期基金份额净值增长率	8.34%	8.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026年06月30日)	
期末可供分配利润	6,121,775.08	3,700,483.43
期末可供分配基金份额利润	0.2531	0.2492
期末基金资产净值	30,620,693.55	18,740,064.71
期末基金份额净值	1.2661	1.2621
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	26.61%	26.21%

注：

1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如：基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

富安达中证A500指数增强A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.45%	1.29%	13.54%	1.34%	-3.09%	-0.05%
过去六个月	8.34%	1.20%	11.34%	1.22%	-3.00%	-0.02%
过去一年	25.33%	1.05%	34.41%	1.09%	-9.08%	-0.04%
自基金合同生效起至今	26.61%	0.94%	35.52%	1.10%	-8.91%	-0.16%

富安达中证A500指数增强C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.37%	1.29%	13.54%	1.34%	-3.17%	-0.05%
过去六个月	8.20%	1.20%	11.34%	1.22%	-3.14%	-0.02%
过去一年	25.01%	1.05%	34.41%	1.09%	-9.40%	-0.04%
自基金合同生效起至今	26.21%	0.94%	35.52%	1.10%	-9.31%	-0.16%

注：

1．本基金业绩比较基准为中证A500指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

2．本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

Return t =95%×[中证A500指数收益率t÷中证A500指数收益率(t-1)-1]+5%×[银行活期存款利率（税后）t÷银行活期存款利率（税后）(t-1)-1]

Benchmark t =(1+ Return t)×Benchmark(t-1)

其中，t =1，2，3，...T，T 表示时间截至日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注：根据本基金《基金合同》规定，本基金建仓期为6个月，建仓截止日为2025年9月30日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富安达基金管理有限公司由南京证券股份有限公司、江苏交通控股有限公司、南京市河西新城区国有资产经营控股（集团）有限责任公司三家单位共同发起设立。2021年6月29日，经中国证券监督管理委员会证监许可【2021】2276号文批准，江苏交通控股有限公司将其持有的本公司股权转让给江苏云杉资本管理有限公司。公司办公地点为上海浦东世纪大道1568号中建大厦，注册资本8.18亿元人民币。公司秉承诚信、稳健、规范、创新的经营理念，以基金持有人利益最大化为首要经营目标，为客户提供卓越的理财服务。

截至2026年6月30日，公司共管理二十七只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
纪青	本基金的基金经理、指数与量化投资部副经理（主持工作）	2025-04-01	-	18年	硕士。历任中海基金投研中心金融工程分析师。2013年加入富安达基金管理有限公司。现任指数与量化投资部副经理（主持工作），富安达中证500指数增强型证券投资基金、富安达中小盘六个月持有期混合型发起式证券投资基金、富安达沪深300指数增强型证券投资基金、富安达中证A500指数增强型证券投资基金、富安达上证科创板综合指数增强型证券投资基金的基金经理。曾任富安达健康人生灵活配置混合型证券投资基金、富安达长盈灵活配置混合型证券投资基金、富安达智优量化选股混合型发

					起式证券投资基金的基金经理。2022年7月至2022年11月兼任投资经理。
唐智俊	本基金的基金经理助理	2026-02-02	-	11年	硕士。历任富安达基金管理有限公司金融工程研究员；富安达资产管理（上海）有限公司投资经理、研究员。2025年加入富安达基金管理有限公司，现任指数与量化投资部研究员、富安达中证500指数增强型证券投资基金、富安达中小盘六个月持有期混合型发起式证券投资基金、富安达沪深300指数增强型证券投资基金、富安达中证A500指数增强型证券投资基金、富安达上证科创板综合指数增强型证券投资基金的基金经理助理。曾任富安达智优量化选股混合型发起式证券投资基金的基金经理助理。

注：

1、基金经理任职日期和离任日期为公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金的基金经理，即基金的首任基金经理，其任职日期为基金合同生效日，其离职日期为公司作出决定后正式对外公告之日；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其各项实施准则、《富安达中证A500指数增强型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额

持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《富安达基金管理有限公司公平交易制度》，并建立了健全有效的公平交易执行和监控体系，涵盖了所有投资组合，并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节，确保公平对待旗下的每一个投资组合。本报告期内，公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《富安达基金管理有限公司公平交易制度》。

截止报告日，公司完成了各基金公平交易执行情况的统计分析，按照特定计算周期，分1日、3日和5日时间窗分析同向和反向交易的价格差异，未发现公平交易异常情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026年上半年A股运行于多重宏观博弈环境之中，行情呈现典型结构性牛市特征。利好维度来看，“十五五”规划配套政策有序落地，产业政策由前期预期演绎进入实质执行阶段；PPI环比上行带动上市企业盈利边际修复，国内货币政策维持宽松基调，社保基金、保险资金、北向资金等长线机构资金持续净流入，为权益市场提供稳定增量。与此同时多重压制因素形成对冲：中东地缘博弈推升全球滞胀交易预期，市场对美联储降息的定价有所下修，海外流动性边际收紧通过跨境渠道对A股形成外部扰动；国内端消费复苏斜率平缓、地产投资景气度偏弱，实体有效信贷需求不足；叠加市场估值修复后重要股东减持供给放量，多重因素共同牵引宽基指数区间震荡下行。板块层面行业分化显著，科技成长赛道内半导体、人工智能产业链领涨全市场，传统消费、传统周期板块阶段性跑输基准。因子维度，动量、盈利类因子兑现度较好，反转、小市值风格因子阶段性表现钝化，使得以价量特征为核心输入的机器学习类策略整体业绩承压。

回到本基金运作层面，本期依托多因子量化选股体系开展指数增强投资，受深度学习子模型当期信号有效性下行影响，组合相对业绩基准的超额收益阶段性偏弱，后续我们将针对模型参数开展迭代优化，动态调整因子权重与样本训练窗口，力争修复超额获取能力。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末富安达中证A500指数增强A基金份额净值为1.2661元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为8.34%，同期业绩比较基准收益率为11.34%；截至报告期末富安达中证A500指数增强C基金份额净值为1.2621元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为8.20%，同期业绩比较基准收益率为11.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2026年下半年，国内宏观经济大概率延续K型分化的运行特征，预计宏观调控政策将在稳增长、防通胀、产业转型升级三大目标间动态统筹、相机施策。外部层面，中东地缘冲突或将抬升全球通胀中枢，海外经济维持低速增长态势，跨境权益市场波动率中枢上行，外部不确定性对国内市场的扰动需持续跟踪。落脚A股权益市场，慢牛的中长期运行逻辑并未发生改变。结构维度上，人工智能赛道产业景气度确定性较强，产业链企业资本开支处于上行周期，科技成长仍是核心主线，但投资上需深耕细分赛道、聚焦优质龙头；周期板块有望依托大宗商品涨价催化释放阶段性收益弹性；消费板块盈利基本面边际改善叠加估值修复窗口打开，配置价值有望逐步显现。整体来看，市场或将演绎结构性轮动行情，前期极致分化的风格格局有望逐步向均衡风格收敛。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司总经理担任估值委员会主席，估值委员会成员由公司总经理、督察长、首席信息官、基金经理、以及权益投资部、研究发展部、固定收益部、多资产投资部、监察稽核部和基金事务部负责人组成，公司其他高级管理人员可列席参会。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议；可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，参与估值程度和估值技术的讨论，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在富安达中证A500指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，富安达基金管理有限公司在富安达中证A500指数增强型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由富安达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关富安达中证A500指数增强型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：富安达中证A500指数增强型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,730,958.80	3,703,009.44
结算备付金		140,961.25	140,316.47
存出保证金		-	-

交易性金融资产	6.4.7.2	46,597,679.70	56,264,512.20
其中：股票投资		46,597,679.70	56,264,512.20
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		26,714.47	904,301.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		49,496,314.22	61,012,139.78
负债和净资产	**附注号**	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		38,325.17	490,874.34
应付管理人报酬		32,302.35	43,321.39
应付托管费		4,037.77	5,415.17
应付销售服务费		3,863.01	5,151.83
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	57,027.66	35,000.00
负债合计		135,555.96	579,762.73
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	39,034,281.60	51,752,469.30
未分配利润	6.4.7.8	10,326,476.66	8,679,907.75
净资产合计		49,360,758.26	60,432,377.05
负债和净资产总计		49,496,314.22	61,012,139.78

注： 报告截止日2026年6月30日，富安达中证A500指数增强A份额净值1.2661元，基金份额总额24,185,902.26份，富安达中证A500指数增强C份额净值1.2621元，基金份额总额14,848,379.34份，总份额合计39,034,281.60份。

6.2 利润表

会计主体：富安达中证A500指数增强型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日
一、营业总收入		4,746,785.71	3,562,445.71
1.利息收入		4,373.06	842,990.51
其中：存款利息收入	6.4.7.9	4,373.06	456,489.20
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	386,501.31
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,838,063.82	1,082,901.25
其中：股票投资收益	6.4.7.10	3,326,580.98	159,565.43

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	511,482.84	923,335.82
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	904,288.29	1,636,050.63
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	60.54	503.32
减：二、营业总支出		321,218.06	871,609.02
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	212,182.85	667,683.92
2.托管费	6.4.10.2.2	26,522.78	83,460.49
3.销售服务费	6.4.10.2.3	25,484.76	68,636.34
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		-	1,391.41
8.其他费用	6.4.7.19	57,027.67	50,436.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,425,567.65	2,690,836.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,425,567.65	2,690,836.69
五、其他综合收益的税后净额		-	-

六、综合收益总额		4,425,567.65	2,690,836.69

6.3 净资产变动表

会计主体：富安达中证A500指数增强型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	51,752,469.30	8,679,907.75	60,432,377.05
二、本期期初净资产	51,752,469.30	8,679,907.75	60,432,377.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-12,718,187.70	1,646,568.91	-11,071,618.79
（一）、综合收益总额	-	4,425,567.65	4,425,567.65
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-12,718,187.70	-2,778,998.74	-15,497,186.44
其中：1.基金申购款	13,242,299.42	2,830,715.06	16,073,014.48
2.基金赎回款	-25,960,487.12	-5,609,713.80	-31,570,200.92
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	39,034,281.60	10,326,476.66	49,360,758.26

项 目	上年度可比期间 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	425,110,529.42	-	425,110,529.42
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-215,331,791.69	2,109,571.09	-213,222,220.60
（一）、综合收益总额	-	2,690,836.69	2,690,836.69
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-215,331,791.69	-581,265.60	-215,913,057.29
其中：1.基金申购款	6,195,733.44	17,976.80	6,213,710.24
2.基金赎回款	-221,527,525.13	-599,242.40	-222,126,767.53
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	209,778,737.73	2,109,571.09	211,888,308.82

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

王胜	孙爱民	王雪
————————	————————	————————
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富安达中证A500指数增强型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2025]38号《关于准予富安达中证A500指数增强型证券投资基金注册的批复》注册，由富安达基金管理有限公司(以下简称"富安达基金")依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《富安达中证A500指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币424,985,726.06元，业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第2500274号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《富安达中证A500指数增强型证券投资基金基金合同》于2025年4月1日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为425,110,529.42份基金份额，其中认购资金利息折合124,803.36份基金份额。本基金的基金管理人为富安达基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《富安达中证A500指数增强型证券投资基金基金合同》和《富安达中证A500指数增强型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用、但不从本类别基金财产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金财产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定以及《富安达中证A500指数增强型证券投资基金基金合同》等法律文件约定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、科创板以及其他经中国证监会允许发行上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债券、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、公开发行的次级债、分离交易可转债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权）、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票及存托凭证资产的比例不低于基金资产的80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本

基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证A500指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金2026年6月30日的财务状况、自2026年1月1日至2026年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期内所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政

策的补充通知》、财税 [2016] 140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023] 39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025] 4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

b) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

d) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	943,760.39
等于：本金	943,685.05
加：应计利息	75.34
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	1,787,198.41
等于：本金	1,787,170.88
加：应计利息	27.53
减：坏账准备	-
合计	2,730,958.80

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		43,464,344.39	-	46,597,679.70	3,133,335.31
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-

	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		43,464,344.39	-	46,597,679.70	3,133,335.31

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有任何衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本报告期末未持有任何买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
应付审计费	17,356.09
应付信息披露费	39,671.58

其他应付	-0.01
合计	57,027.66

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 富安达中证A500指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (富安达中证A500指数增强A)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	31,156,489.34	31,156,489.34
本期申购	12,561,420.84	12,561,420.84
本期赎回（以“-”号填列）	-19,532,007.92	-19,532,007.92
本期末	24,185,902.26	24,185,902.26

6.4.7.7.2 富安达中证A500指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (富安达中证A500指数增强C)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	20,595,979.96	20,595,979.96
本期申购	680,878.58	680,878.58
本期赎回（以“-”号填列）	-6,428,479.20	-6,428,479.20
本期末	14,848,379.34	14,848,379.34

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 富安达中证A500指数增强A

单位：人民币元

项目 (富安达中证A500指数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,451,126.29	-198,302.12	5,252,824.17

本期期初	5,451,126.29	-198,302.12	5,252,824.17
本期利润	2,080,576.61	620,268.01	2,700,844.62
本期基金份额交易产生的变动数	-1,409,927.82	-108,949.68	-1,518,877.50
其中：基金申购款	2,885,158.15	-200,977.21	2,684,180.94
基金赎回款	-4,295,085.97	92,027.53	-4,203,058.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,121,775.08	313,016.21	6,434,791.29

6.4.7.8.2 富安达中证A500指数增强C

单位：人民币元

项目 (富安达中证A500指数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,557,748.00	-130,664.42	3,427,083.58
本期期初	3,557,748.00	-130,664.42	3,427,083.58
本期利润	1,440,702.75	284,020.28	1,724,723.03
本期基金份额交易产生的变动数	-1,297,967.32	37,846.08	-1,260,121.24
其中：基金申购款	161,746.16	-15,212.04	146,534.12
基金赎回款	-1,459,713.48	53,058.12	-1,406,655.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,700,483.43	191,201.94	3,891,685.37

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	3,062.50
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	665.78
结算备付金利息收入	644.78

其他	-
合计	4,373.06

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	225,486,374.47
减：卖出股票成本总额	221,925,083.43
减：交易费用	234,710.06
买卖股票差价收入	3,326,580.98

6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金在本报告期内无股票投资证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

本基金在本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金在本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	511,482.84

其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	511,482.84

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	904,288.29
——股票投资	904,288.29
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	904,288.29

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	60.54
合计	60.54

6.4.7.18 信用减值损失

本基金在本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	17,356.09
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
合计	57,027.67

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，关联方、关联关系未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南京证券股份有限公司("南京证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
交通银行股份有限公司("交通银行")	基金托管人、基金销售机构
富安达基金管理有限公司("富安达基金")	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
富安达资产管理（上海）有限公司("富安达资管")	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
南京证券	335,598,589.50	76.82%	172,219,381.67	78.24%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
南京证券	-	-	4,933,578,000.00	76.09%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日

	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
南京证券	71,609.01	76.15%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
南京证券	82,248.51	75.73%	-	-

注：

1、上述佣金按协议约定的佣金计算，佣金率参考市场价格经协议签订方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括本基金管理人从南京证券获得证券研究综合服务；

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。公司的该类佣金协议符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	212,182.85	667,683.92
其中：应支付销售机构的客户维护费	76,362.64	323,050.50
应支付基金管理人的净管理费	135,820.21	344,633.42

注：
1.支付基金管理人富安达基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费＝前一日基金资产净值×0.80%/当年实际天数。

2.客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	26,522.78	83,460.49

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年实际天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富安达中证A500指数增强A	富安达中证A500指数增强C	合计
交通银行	0.00	11,700.26	11,700.26
南京证券	0.00	390.34	390.34
富安达基金	0.00	8,169.82	8,169.82
合计	0.00	20,260.42	20,260.42
获得销售服务费的	上年度可比期间 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日		

各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	富安达中证A500指数增强A	富安达中证A500指数增强C	合计
交通银行	0.00	52,062.03	52,062.03
南京证券	0.00	44.07	44.07
富安达基金	0.00	3,438.70	3,438.70
合计	0.00	55,544.80	55,544.80

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日C类资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：日基金销售服务费=C类基金份额前一日基金资产净值 ×0.25% / 当年实际天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

富安达中证A500指数增强A

份额单位：份

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日

基金合同生效日（2025年04月01日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	3,624,777.09	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	3,624,777.09	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	14.99%	-

注：1、本报告期和上年度可比期间，基金管理人未发生运用固有资金投资富安达中证A500指数增强C的情况。

2、基金管理人投资本基金适用的费率按照招募说明书的规定执行，下同。

3、持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

富安达中证A500指数增强A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
富安达资管	4,883,968.84	20.19%	0.00	0.00%

注：1、本期末和上年度末除基金管理人之外的其他关联方未发生投资富安达中证A500指数增强C的情况。

2、持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名	本期	上年度可比期间

称	2026年01月01日至2026年06月30日		2025年04月01日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	943,760.39	3,062.50	2,227,442.43	16,087.16

注：1、本基金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2026年6月30日的相关余额为人民币0.00元。（2025年6月30日：人民币0.00元）

2、本基金券商资金账户的存款为本基金存放于南京证券专用证券账户的证券交易结算资金， 按协议约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金在本报告期内未进行过利润分配。

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于2026年6月30日，本基金未持有因认购新发或增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2026年6月30日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于2026年6月30日，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于2026年6月30日，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于2026年6月30日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成分股及其备选成分股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金作为增强型的指数基金，以量化组合投资管理方式为基础，力求在控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%、年跟踪误差不超过8.0%的基础上获取超越标的指数的表现。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。本基金面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。与本基金相关的市场风险主要是利率风险和其他价格风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现在股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置与稳健投资下，获取长期持续稳定的合理回报的投资目标。

本基金的基金管理人建立了规范的投资管理流程和严格的风险管理体系，贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评估的全过程。本基金的基金管理人已制定针对以上金融工具风险的管理政策和控制制度，并且形成了由本基金的基金管理人在公司层面建立的风险控制委员会以及在董事会层面建立的合规与风险控制委员会负责对与所投资金融工具相关的风险类型、管理政策和各种投资限制的定期回顾、评估和修改，本基金的基金管理人的风险管理部门负责具体落实和日常跟踪的工作机制。

本基金的基金管理人设立了独立于各业务部门的监察稽核部，其中监察稽核人员履行内部稽核职能，检查、评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司内部控制制度的执行情况，揭示公司内部管理及基金运作中的风险，及时提出改进意见，促进公司内部管理制度有效地执行。监察稽核人员具有相对的独立性，定期出具监察稽核报告，报公司督察长、董事。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交

收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2026年6月30日，本基金无债券投资(2025年12月31日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2026年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投

资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2026年6月30日，本基金无流动性受限资产。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2026年6月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金和结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2026年0	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

6月30日					
资产					
货币资金	2,730,958.80	-	-	-	2,730,958.80
结算备付金	140,961.25	-	-	-	140,961.25
交易性金融资产	-	-	-	46,597,679.70	46,597,679.70
应收申购款	-	-	-	26,714.47	26,714.47
资产总计	2,871,920.05	-	-	46,624,394.17	49,496,314.22
负债					
应付赎回款	-	-	-	38,325.17	38,325.17
应付管理人报酬	-	-	-	32,302.35	32,302.35
应付托管费	-	-	-	4,037.77	4,037.77
应付销售服务费	-	-	-	3,863.01	3,863.01
其他负债	-	-	-	57,027.66	57,027.66
负债总计	-	-	-	135,555.96	135,555.96
利率敏感度缺口	2,871,920.05	-	-	46,488,838.21	49,360,758.26
上年度末2025年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

货币资金	3,703,009.44	-	-	-	3,703,009.44
结算备付金	140,316.47	-	-	-	140,316.47
交易性金融资产	-	-	-	56,264,512.20	56,264,512.20
应收申购款	-	-	-	904,301.67	904,301.67
资产总计	3,843,325.91	-	-	57,168,813.87	61,012,139.78
负债					
应付赎回款	-	-	-	490,874.34	490,874.34
应付管理人报酬	-	-	-	43,321.39	43,321.39
应付托管费	-	-	-	5,415.17	5,415.17
应付销售服务费	-	-	-	5,151.83	5,151.83
其他负债	-	-	-	35,000.00	35,000.00
负债总计	-	-	-	579,762.73	579,762.73
利率敏感度缺口	3,843,325.91	-	-	56,589,051.14	60,432,377.05

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2026年6月30日，本基金未持有交易性金融资产-债券投资(2025年12月31日：同)。因此，市场利率的变动对本基金净资产无重大影响(2025年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用自上而下的富安达多维经济模型，通过对全球经济发展形势，国内经济情况及经济政策、物价水平变动趋势、资金供求关系和市场估值的分析，结合FED模型，对未来一定时期各大类资产的收益风险变化趋势作出预测，并据此适时动态的调整本基金在股票、债券、现金等资产之间的配置比例。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产－股票投资	46,597,679.70	94.40	56,264,512.20	93.10
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
交易性金融资	-	-	-	-

产－贵金属投资				
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	46,597,679.70	94.40	56,264,512.20	93.10

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证A500指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	1.中证A500指数上升5%	2,728,760.12	2,727,422.23
	2.中证A500指数下降5%	-2,728,760.12	-2,727,422.23

注：本基金本期末其他价格风险的敏感性计算中所使用的β系数为股票组合的β系数，即资产负债表日投资组合内各个股票的β加权平均。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日

第一层次	46,597,679.70	55,996,558.20
第二层次	-	267,954.00
第三层次	-	-
合计	46,597,679.70	56,264,512.20

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期内及上年度可比期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2026年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。(2025年12月31日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2026年6月30日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	46,597,679.70	94.14
	其中：股票	46,597,679.70	94.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-

6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,871,920.05	5.80
8	其他各项资产	26,714.47	0.05
9	合计	49,496,314.22	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	230,934.00	0.47
B	采矿业	1,627,478.00	3.30
C	制造业	29,065,463.58	58.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	980,277.00	1.99
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	690,000.00	1.40
G	交通运输、仓储和邮政业	1,244,472.00	2.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,839,157.90	3.73
J	金融业	3,379,408.00	6.85
K	房地产业	300,371.00	0.61
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	821,766.00	1.66
N	水利、环境和公共设施管理业	261,332.00	0.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	40,440,659.48	81.93

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	44,289.00	0.09
B	采矿业	404,700.00	0.82
C	制造业	4,467,568.90	9.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	49,200.00	0.10
F	批发和零售业	157,242.00	0.32
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	579,647.32	1.17
J	金融业	281,692.00	0.57
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	37,231.00	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	135,450.00	0.27
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,157,020.22	12.47

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末无港股通投资股票投资组合。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	1,700	2,159,000.00	4.37
2	300750	宁德时代	4,500	1,768,545.00	3.58
3	688041	海光信息	2,388	884,276.40	1.79
4	600519	贵州茅台	700	829,843.00	1.68
5	603259	药明康德	6,600	821,766.00	1.66
6	603986	兆易创新	1,000	815,000.00	1.65
7	000333	美的集团	10,555	797,219.15	1.62
8	300502	新易盛	1,260	764,820.00	1.55
9	300475	香农芯创	2,300	690,000.00	1.40
10	002384	东山精密	2,600	682,110.00	1.38
11	300857	协创数据	2,000	679,800.00	1.38
12	300476	胜宏科技	1,600	554,288.00	1.12
13	000651	格力电器	14,700	551,250.00	1.12
14	600900	长江电力	20,800	550,576.00	1.12
15	688012	中微公司	1,157	542,054.50	1.10
16	000338	潍柴动力	18,900	515,025.00	1.04
17	600030	中信证券	17,200	494,156.00	1.00
18	300124	汇川技术	7,400	490,842.00	0.99
19	002475	立讯精密	6,700	471,680.00	0.96
20	300014	亿纬锂能	7,200	468,216.00	0.95
21	300803	指南针	4,400	403,348.00	0.82
22	300408	三环集团	2,400	400,560.00	0.81

23	688498	源杰科技	200	377,200.00	0.76
24	601318	中国平安	7,900	377,146.00	0.76
25	000001	平安银行	37,500	376,875.00	0.76
26	300223	北京君正	1,500	373,350.00	0.76
27	000408	藏格矿业	5,300	367,396.00	0.74
28	002463	沪电股份	2,400	366,720.00	0.74
29	600938	中国海油	13,200	358,380.00	0.73
30	688008	澜起科技	1,149	356,075.10	0.72
31	600989	宝丰能源	17,400	353,742.00	0.72
32	600887	伊利股份	14,700	352,212.00	0.71
33	301308	江波龙	500	351,900.00	0.71
34	000988	华工科技	1,900	350,759.00	0.71
35	601166	兴业银行	20,800	344,448.00	0.70
36	688002	睿创微纳	2,140	331,036.60	0.67
37	688256	寒武纪	200	319,110.00	0.65
38	600522	中天科技	5,200	315,536.00	0.64
39	002281	光迅科技	1,200	308,328.00	0.62
40	601211	国泰海通	16,900	307,580.00	0.62
41	300049	福瑞医科	7,900	307,152.00	0.62
42	601398	工商银行	42,700	301,889.00	0.61
43	002008	大族激光	2,000	300,220.00	0.61
44	002532	天山铝业	27,900	299,367.00	0.61
45	600036	招商银行	8,300	294,650.00	0.60
46	600549	厦门钨业	3,400	289,680.00	0.59
47	688469	芯联集成	25,814	273,886.54	0.55
48	002415	海康威视	8,000	273,600.00	0.55
49	300661	圣邦股份	1,900	272,612.00	0.55
50	002851	麦格米特	1,600	267,488.00	0.54
51	600150	中国船舶	7,900	266,941.00	0.54
52	002049	紫光国微	3,000	266,250.00	0.54
53	601328	交通银行	40,800	262,344.00	0.53

54	300073	当升科技	5,400	259,416.00	0.53
55	601899	紫金矿业	10,300	258,942.00	0.52
56	600418	江淮汽车	10,000	258,300.00	0.52
57	002353	杰瑞股份	1,600	244,000.00	0.49
58	601816	京沪高铁	52,400	237,372.00	0.48
59	300458	全志科技	6,000	236,760.00	0.48
60	002714	牧原股份	6,600	230,934.00	0.47
61	688099	晶晨股份	2,242	230,701.80	0.47
62	000066	中国长城	12,000	228,600.00	0.46
63	601872	招商轮船	13,000	228,410.00	0.46
64	000792	盐湖股份	7,500	226,425.00	0.46
65	605117	德业股份	2,100	222,978.00	0.45
66	600660	福耀玻璃	4,400	221,936.00	0.45
67	002709	天赐材料	4,300	221,149.00	0.45
68	688047	龙芯中科	1,428	220,868.76	0.45
69	600879	航天电子	10,300	219,287.00	0.44
70	601088	中国神华	5,600	218,624.00	0.44
71	002558	巨人网络	7,900	217,724.00	0.44
72	600000	浦发银行	25,200	216,972.00	0.44
73	603799	华友钴业	4,400	212,344.00	0.43
74	002821	凯莱英	1,300	210,600.00	0.43
75	601985	中国核电	23,300	210,399.00	0.43
76	300438	鹏辉能源	2,500	207,125.00	0.42
77	002738	中矿资源	3,500	206,465.00	0.42
78	002422	科伦药业	5,300	204,156.00	0.41
79	300450	先导智能	5,000	203,600.00	0.41
80	688676	金盘科技	2,400	203,136.00	0.41
81	300418	昆仑万维	5,000	201,800.00	0.41
82	601689	拓普集团	3,500	197,470.00	0.40
83	301358	湖南裕能	2,600	197,262.00	0.40
84	688180	君实生物	5,678	192,029.96	0.39

85	601021	春秋航空	4,200	191,436.00	0.39
86	300724	捷佳伟创	2,700	190,620.00	0.39
87	000623	吉林敖东	10,700	189,711.00	0.38
88	600352	浙江龙盛	15,600	188,916.00	0.38
89	000426	兴业银锡	5,700	187,872.00	0.38
90	600875	东方电气	6,500	187,005.00	0.38
91	002444	巨星科技	6,000	186,600.00	0.38
92	600026	中远海能	10,300	184,782.00	0.37
93	688111	金山办公	862	183,649.10	0.37
94	600066	宇通客车	6,700	179,627.00	0.36
95	601567	三星电气	11,800	176,292.00	0.36
96	000423	东阿阿胶	3,800	172,368.00	0.35
97	600233	圆通速递	10,900	171,675.00	0.35
98	600323	瀚蓝环境	6,200	170,252.00	0.34
99	002756	永兴材料	3,000	169,920.00	0.34
100	688472	阿特斯	15,644	169,268.08	0.34
101	001965	招商公路	18,100	165,796.00	0.34
102	002078	太阳纸业	13,200	164,868.00	0.33
103	688223	晶科能源	34,574	164,226.50	0.33
104	300432	富临精工	8,000	160,720.00	0.33
105	688981	中芯国际	1,000	158,820.00	0.32
106	002544	普天科技	8,700	158,514.00	0.32
107	000039	中集集团	19,500	158,145.00	0.32
108	600499	科达制造	11,400	157,320.00	0.32
109	600941	中国移动	1,800	155,034.00	0.31
110	600886	国投电力	11,600	154,396.00	0.31
111	000975	山金国际	9,000	153,000.00	0.31
112	601155	新城控股	14,700	150,822.00	0.31
113	600048	保利发展	32,300	149,549.00	0.30
114	600535	天士力	11,300	149,499.00	0.30
115	603993	洛阳钼业	8,500	149,175.00	0.30

116	603833	欧派家居	4,900	147,539.00	0.30
117	000683	博源化工	25,300	145,728.00	0.30
118	601728	中国电信	28,000	145,320.00	0.29
119	000933	神火股份	6,800	144,160.00	0.29
120	600711	盛屯矿业	13,000	142,610.00	0.29
121	600489	中金黄金	7,900	142,595.00	0.29
122	300454	深信服	1,400	134,680.00	0.27
123	300751	迈为股份	400	112,984.00	0.23
124	002126	银轮股份	1,900	94,620.00	0.19
125	002517	恺英网络	5,700	92,625.00	0.19
126	002266	浙富控股	18,000	91,080.00	0.18
127	002371	北方华创	100	88,456.00	0.18
128	002837	英维克	1,100	87,516.00	0.18
129	300919	中伟新材	1,900	83,125.00	0.17
130	600104	上汽集团	8,500	82,960.00	0.17
131	688122	西部超导	1,279	80,333.99	0.16
132	601006	大秦铁路	14,100	65,001.00	0.13
133	003816	中国广核	16,600	64,906.00	0.13
134	600177	雅戈尔	5,600	42,168.00	0.09
135	002466	天齐锂业	400	24,528.00	0.05
136	002050	三花智控	400	17,532.00	0.04
137	601225	陕西煤业	800	16,280.00	0.03

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688729	屹唐股份	6,459	277,737.00	0.56
2	301536	星宸科技	2,000	257,420.00	0.52
3	301086	鸿富瀚	1,200	251,136.00	0.51

4	300870	欧陆通	700	241,983.00	0.49
5	688045	必易微	2,678	216,328.84	0.44
6	688653	康希通信	12,026	209,011.88	0.42
7	600999	招商证券	9,400	198,340.00	0.40
8	300842	帝科股份	2,200	196,174.00	0.40
9	688230	芯导科技	2,413	190,168.53	0.39
10	688709	成都华微	4,870	185,498.30	0.38
11	002402	和而泰	7,000	180,810.00	0.37
12	002841	视源股份	5,000	172,650.00	0.35
13	300285	国瓷材料	1,600	165,088.00	0.33
14	300916	朗特智能	7,000	163,590.00	0.33
14	300590	移为通信	11,400	163,590.00	0.33
15	300953	震裕科技	1,200	160,440.00	0.33
16	301097	天益医疗	4,481	159,971.70	0.32
17	601061	中信金属	14,600	157,242.00	0.32
18	603345	安井食品	1,900	152,361.00	0.31
19	000923	河钢资源	12,000	148,920.00	0.30
20	301159	三维天地	5,100	148,410.00	0.30
21	301272	英华特	4,500	148,230.00	0.30
22	301388	欣灵电气	6,200	144,584.00	0.29
23	601138	工业富联	2,000	144,300.00	0.29
24	301329	信音电子	5,900	143,311.00	0.29
25	301042	安联锐视	2,140	142,738.00	0.29
26	688262	国芯科技	3,276	141,621.48	0.29
27	002379	宏桥控股	9,400	138,838.00	0.28
28	688081	兴图新科	3,385	138,378.80	0.28
29	300774	倍杰特	12,600	135,450.00	0.27
30	000603	盛达资源	5,800	133,980.00	0.27
31	600933	爱柯迪	9,000	133,020.00	0.27
32	000983	山西焦煤	21,000	121,800.00	0.25
33	688385	复旦微电	1,357	96,740.53	0.20

34	600155	华创云信	15,100	83,352.00	0.17
35	688692	达梦数据	300	73,287.00	0.15
36	688539	高华科技	1,582	50,434.16	0.10
37	301098	金埔园林	6,000	49,200.00	0.10
38	002458	益生股份	5,700	44,289.00	0.09
39	300564	筑博设计	3,100	37,231.00	0.08
40	002032	苏泊尔	900	35,640.00	0.07
41	001389	广合科技	100	23,725.00	0.05

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688041	海光信息	1,562,212.79	2.59
2	601398	工商银行	1,560,085.00	2.58
3	688981	中芯国际	1,501,648.24	2.48
4	603259	药明康德	1,501,238.00	2.48
5	300308	中际旭创	1,479,721.00	2.45
6	600900	长江电力	1,454,633.00	2.41
7	601600	中国铝业	1,446,373.00	2.39
8	002475	立讯精密	1,427,673.00	2.36
9	600031	三一重工	1,399,878.00	2.32
10	600150	中国船舶	1,340,487.00	2.22
11	000063	中兴通讯	1,310,928.00	2.17
12	600989	宝丰能源	1,249,570.00	2.07
13	002714	牧原股份	1,206,375.00	2.00
14	000792	盐湖股份	1,206,296.00	2.00
15	000651	格力电器	1,166,501.00	1.93
16	002415	海康威视	1,159,470.00	1.92

17	600938	中国海油	1,157,062.00	1.91
18	601899	紫金矿业	1,146,518.00	1.90
19	601166	兴业银行	1,121,512.00	1.86
20	601211	国泰海通	1,108,136.00	1.83

注："买入金额"按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601899	紫金矿业	2,231,256.00	3.69
2	601318	中国平安	1,863,710.00	3.08
3	002475	立讯精密	1,798,093.00	2.98
4	688981	中芯国际	1,797,831.84	2.97
5	688041	海光信息	1,747,451.82	2.89
6	688008	澜起科技	1,713,286.77	2.84
7	601398	工商银行	1,668,834.00	2.76
8	300308	中际旭创	1,624,104.00	2.69
9	600031	三一重工	1,522,295.00	2.52
10	300604	长川科技	1,512,674.00	2.50
11	601211	国泰海通	1,399,798.00	2.32
12	000063	中兴通讯	1,399,096.00	2.32
13	601600	中国铝业	1,345,206.00	2.23
14	600887	伊利股份	1,324,696.00	2.19
15	300274	阳光电源	1,301,830.00	2.15
16	601166	兴业银行	1,295,209.00	2.14
17	603259	药明康德	1,272,144.00	2.11
18	300408	三环集团	1,238,239.00	2.05
19	600183	生益科技	1,231,369.00	2.04
20	601857	中国石油	1,225,757.00	2.03

21	600406	国电南瑞	1,213,203.00	2.01

注："卖出金额"按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	211,353,962.64
卖出股票收入（成交）总额	225,486,374.47

注："买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	26,714.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,714.47

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
富安达中证A500指数增强A	281	86,070.83	10,212,791.92	42.23%	13,973,110.34	57.77%
富安达中证A500指数增强C	112	132,574.82	5,200,234.00	35.02%	9,648,145.34	64.98%
合计	393	99,323.87	15,413,025.92	39.49%	23,621,255.68	60.51%

注：基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	富安达中证A500指数增强A	128,744.97	0.53%
	富安达中证A500指数增强C	367,116.58	2.47%
	合计	495,861.55	1.27%

注：持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	富安达中证A500指数增强A	0
	富安达中证A500指数增强C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	富安达中证A500指数增强A	0~10
	富安达中证A500指数增强C	0
	合计	0~10

1、基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金的份额总量数量区间为10万份至50万份（含）。

2、本基金的基金经理持有本基金的份额总量数量区间为0至10万份（含）。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	富安达中证A500指数增强A	富安达中证A500指数增强C
基金合同生效日(2025年04月01日)基金份额总额	277,462,995.39	147,647,534.03
本报告期期初基金份额总额	31,156,489.34	20,595,979.96
本报告期基金总申购份额	12,561,420.84	680,878.58
减：本报告期基金总赎回份额	19,532,007.92	6,428,479.20
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	24,185,902.26	14,848,379.34

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	富安达基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2026年02月09日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	责令改正
受到调查或处罚等措施的原因	投资运作、合规内控
受到处罚的依据	《证券投资基金管理公司管理办法》《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视，已通过完善制度流程、加强合规宣导、强化事后检查等措施完成整改工作，并已通过监管机构检查验收。
其他	无

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人的托管业务部门未受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华金证券	2	101,241,747.61	23.18%	22,430.61	23.85%	-
南京证券	2	335,598,589.50	76.82%	71,609.01	76.15%	-

注：

1、本基金为券商结算模式，本报告期内管理人选择南京证券和华金证券作为证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准如下：

（1）财务状况良好、经营行为规范、具有完备的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

（2）合规风控管理制度健全，具有良好的诚信合规记录，最近一年未因发生重大违规行为而受到证监会处罚；

（3）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合基金证券交易的需要，最近一年未发生重大信息安全事故；

（4）能为公司提供高质量的研究服务；

2、基金证券经纪商的选择程序：基金管理人对潜在签约券商进行必要的尽职调查，确定证券经纪商，然后基金管理人、基金托管人和证券经纪商签订证券经纪服务协议。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期未通过交易单元进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	富安达基金管理有限公司关于通过直销柜台办理公募基金认、申购、转换转入业务费率优惠的公告	规定媒介	2026-01-07
2	富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	规定媒介	2026-01-21
3	富安达中证A500指数增强型证券投资基金2025年第4季度报告	规定媒介	2026-01-21
4	富安达基金管理有限公司关于通过直销柜台办理公募基金认、申购、转换转入业务费率优惠的公告	规定媒介	2026-01-23
5	富安达基金管理有限公司关于终止浦领基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	规定媒介	2026-02-03
6	富安达中证A500指数增强型证券投资基金招募说明书更新提示性公告	规定媒介	2026-02-25
7	富安达中证A500指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（二〇二六年第一号）	规定媒介	2026-02-25
8	富安达中证A500指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	规定媒介	2026-02-25

9	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2026-02-27
10	富安达基金管理有限公司旗下全部基金年度报告提示性公告	规定媒介	2026-03-28
11	富安达中证A500指数增强型证券投资基金2025年年度报告	规定媒介	2026-03-28
12	富安达基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	规定媒介	2026-03-31
13	富安达基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	规定媒介	2026-04-21
14	富安达中证A500指数增强型证券投资基金2026年第1季度报告	规定媒介	2026-04-21
15	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2026-04-27
16	2025年度富安达基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	规定媒介	2026-04-30
17	富安达基金管理有限公司关于系统升级暂停服务的公告	规定媒介	2026-05-20
18	富安达基金管理有限公司关于旗下基金增加万家财富基金销售（天津）有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	规定媒介	2026-06-25

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予富安达中证A500指数增强型证券投资基金注册的文件：

《富安达中证A500指数增强型证券投资基金招募说明书》；

《富安达中证A500指数增强型证券投资基金基金合同》；

《富安达中证A500指数增强型证券投资基金托管协议》。

2、《富安达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

3、基金管理人业务资格批件和营业执照；

4、基金托管人业务资格批件和营业执照；

5、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告；

6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.fadfunds.com）查阅。

富安达基金管理有限公司

二〇二六年八月二十九日